

南方永利 1 年定期开放债券型证券投资 基金（LOF）2018 年年度报告 摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF)	
场内简称	南方永利	
基金主代码	160130	
交易代码	160130	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 4 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	82,081,501.28 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2013 年 6 月 6 日	
下属分级基金的基金简称	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) A	南方永利 1 年定期开放债券 (LOF) C
下属分级基金的交易代码	160130	160132
报告期末下属分级基金的份 额总额	80,044,476.97 份	2,037,024.31 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方永利”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，在非开放期期间原则上组合久期与初始非开放期适当匹配的基础上，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
		郭明
		010-66105799

	电子邮箱	manager@southernfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-889-8899	95588
传真		0755-82763889	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1、南方永利1年定期开放债券（LOF）A

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-1,006,595.78	3,361,851.56	-13,585,109.20
本期利润	-1,228,901.39	4,913,154.38	-10,237,328.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0124	0.0369	-0.0539
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1452	-0.1272	-0.1565
期末基金资产净值	77,633,969.68	114,325,349.15	144,524,033.38
期末基金份额净值	0.970	0.983	0.945
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	44.59%	46.53%	40.87%

2、南方永利1年定期开放债券（LOF）C

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-28,034.75	88,709.76	-483,627.80
本期利润	-46,384.12	145,312.77	-422,573.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0159	0.0323	-0.0604
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1606	-0.1390	-0.1643
期末基金资产净值	1,947,437.98	3,620,976.73	5,094,556.64
期末基金份额净值	0.956	0.973	0.939
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	38.55%	41.02%	36.09%

注：

1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方永利1年定期开放债券（LOF）A

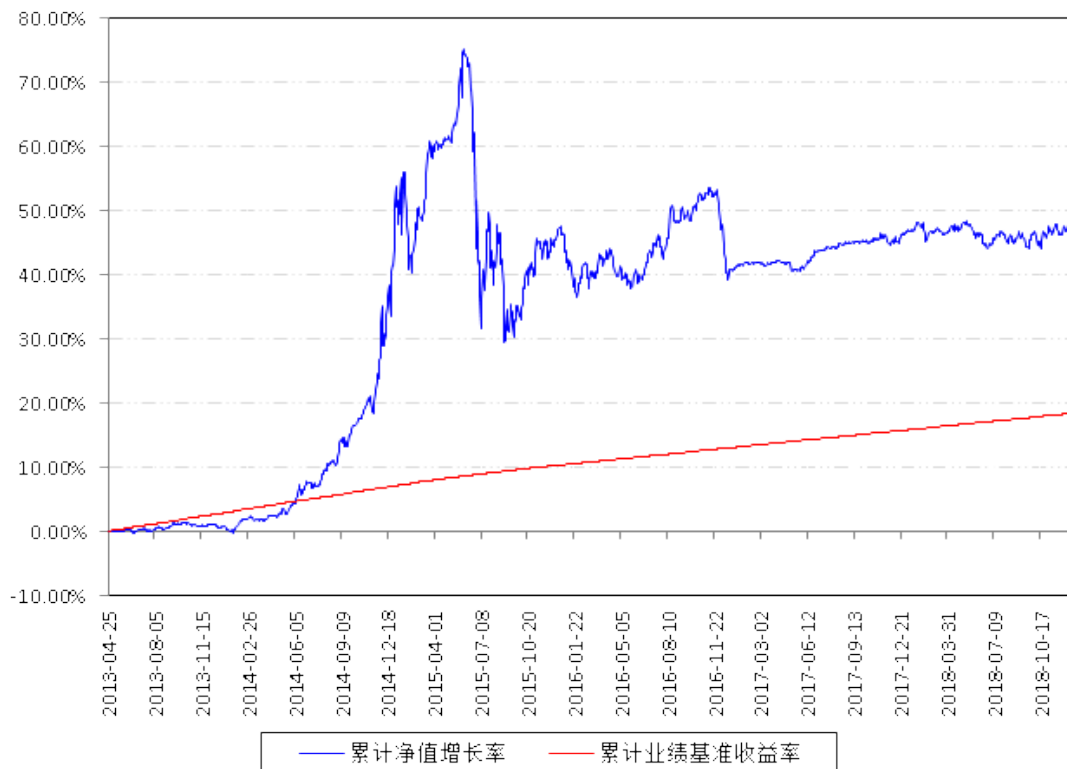
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.52%	0.34%	0.58%	0.01%	-2.10%	0.33%
过去六个月	-0.10%	0.31%	1.16%	0.01%	-1.26%	0.30%
过去一年	-1.32%	0.28%	2.33%	0.01%	-3.65%	0.27%
过去三年	-1.02%	0.35%	7.35%	0.01%	-8.37%	0.34%
过去五年	43.59%	0.77%	15.16%	0.01%	28.43%	0.76%
自基金合同生效起至今	44.59%	0.73%	18.47%	0.01%	26.12%	0.72%

南方永利1年定期开放债券（LOF）C

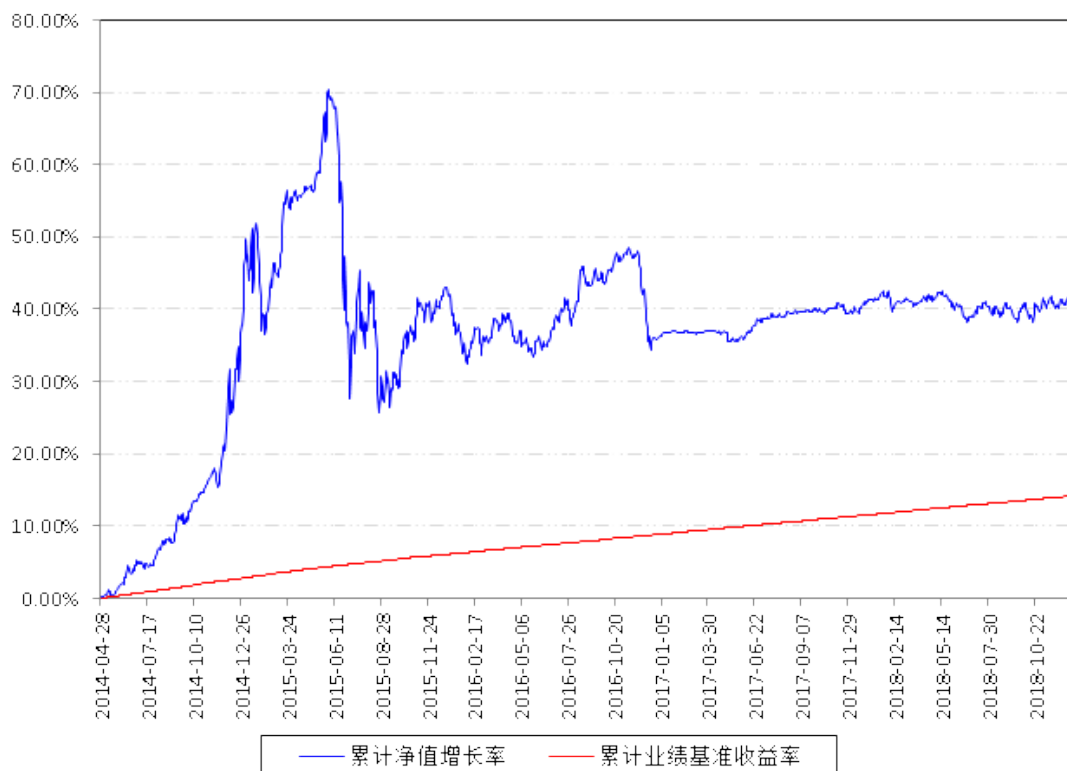
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.65%	0.33%	0.60%	0.01%	-2.25%	0.32%
过去六个月	-0.31%	0.31%	1.21%	0.01%	-1.52%	0.30%
过去一年	-1.75%	0.27%	2.42%	0.01%	-4.17%	0.26%
过去三年	-2.25%	0.35%	7.64%	0.01%	-9.89%	0.34%
自基金合同生效起至今	38.55%	0.80%	14.24%	0.01%	24.31%	0.79%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方永利1年定期开放债券（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方永利1年定期开放债券（LOF）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

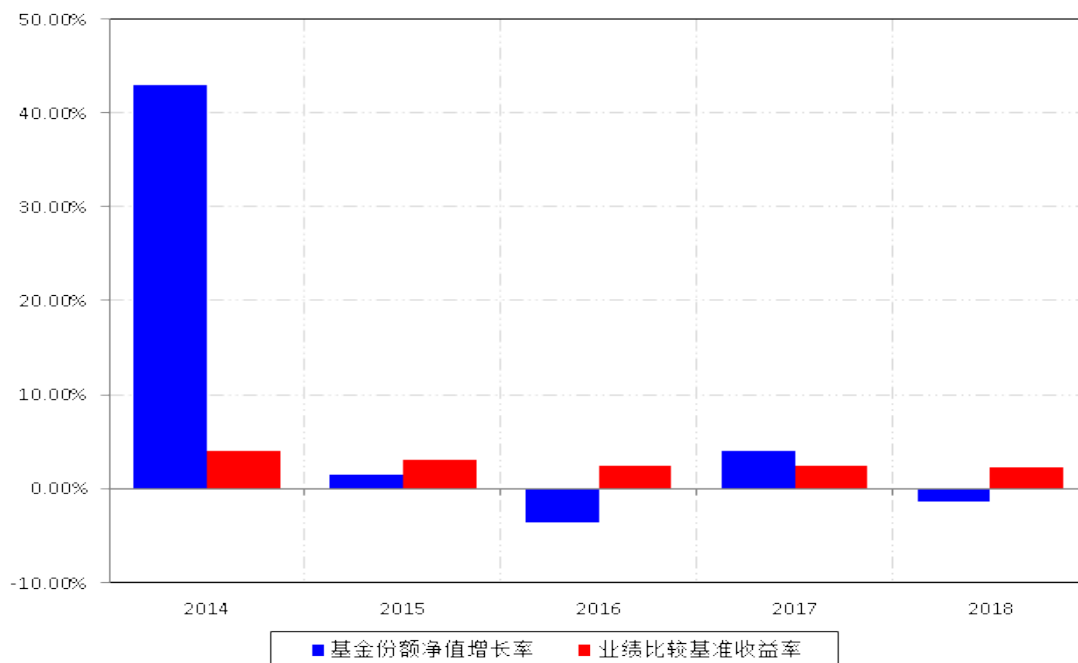


注:

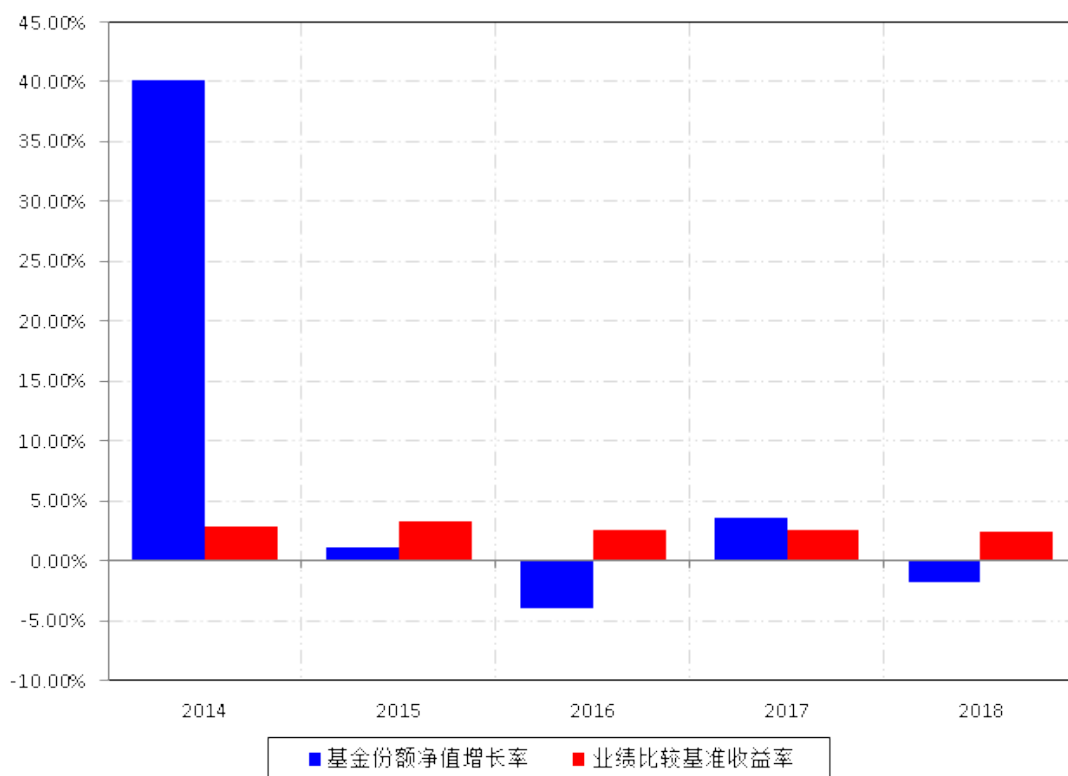
1. 本基金的基金合同生效日为 2013 年 4 月 25 日。
2. 本基金自 2014 年 4 月 28 日起增加 C 类收费模式, 原有收费模式称为 A 类。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方永利1年定期开放债券 (LOF) A 每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



南方永利1年定期开放债券 (LOF) C 每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司，注册资本金3亿元人民币。目前股权结构：华泰证券股份有限公司45%、深圳市投资控股有限公司30%、厦门国际信托有限公司15%及兴业证券股份有限公司10%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模近8,300亿元，旗下管理178只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金和专户理财投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文良	本基金基金经理	2015年8月20日	-	6年	北京大学金融学专业硕士，具有基金从业资格。2012年7月加入南方基金，历任固定收益部转债研究员、宏观研究员、信用分析师；2015年2月至2015年8月，任南方永利基金经理助理；2015年12月至2017年2月，任南方弘利基金经理；2015年12月至2017年5月，任南方安心基金经理；2016年11月至2018年2月，任南方荣发基金经理；2016年11月至2018年2月，任南方卓元基金经理；2017年5月至2018年7月，任南方和利、南方和元、

					南方纯元基金经理；2017年6月至2018年7月，任南方高元基金经理；2015年8月至今，任南方永利基金经理；2016年6月至今，任南方广利基金经理；2016年7月至今，任南方甌智混合基金经理；2017年8月至今，任南方祥元基金经理；2017年9月至今，任南方兴利基金经理；2018年3月至今，任南方希元转债基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：

1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方永利1年定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向

交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 7 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及投资组合的投资策略需要所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

去杠杆带来的信用收缩导致 2018 年经济基本面转弱，货币政策转向宽松，银行间流动性充裕，但 7 月以来的宽信用政策传导不畅，社融增速持续下行，中美贸易战加剧使得市场风险偏好大幅降低，2 月之后走出明显的股熊债牛行情，利率曲线陡峭化下行，全年来看，1 年国债、1 年国开收益率分别下行 119BP、193BP，10 年国债、10 年国开收益率分别下行 65BP、118BP，利率债和高等级信用债表现好于中低评级信用债，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500 指数下跌 33.32%，创业板指数下跌 28.65%。可转债市场规模明显上升，权重较高的金融转债表现相对较好，但整体仍跟随权益市场下行，全年中证转债指数下跌 1.16%。南方永利基金纯债部分以信用债为主，择机参与利率债波段交易，但力度有限，二季度开放期之前提前减仓准备流动性，错失了部分信用利差修复的收益，四季度重点提高了信用债的配置比例，全年来看股票和可转债配置比例偏高，在熊市环境下大幅拖累了净值表现，导致全年组合收益较差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 份额净值为 0.970 元，报告期内，份额净值增长率为-1.32%，同期业绩基准增长率为 2.33%；本基金 C 份额净值为 0.956 元，报告期内，份额净值增长率为-1.75%，同期业绩基准增长率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

纯债方面，2019 年上半年经济增长下行压力较大，美联储进入加息周期末期，海外和汇率因素对我国央行的制约降低，国内货币政策进一步宽松，保持流动性合理充裕的同时，重点疏通利率传导机制，由宽货币、紧信用向宽货币、宽信用过渡，2018 年以利率债和 AAA 信用债为代表的避险资产表现较好，未来半年利率仍处于下行趋势当中，但收益空间显著小于 2018 年，目前龙头房地产和民企、城投债的信用利差仍较高，预计在宽信用逐步

落地的过程中有信用利差收敛的行情。权益方面，考察全部A股动态市盈率与10年国开债收益率的差值，该指标在2018年2月初接近历史极低区间，说明当时权益资产的性价比显著弱于债券，经过一年的股熊债牛，该指标目前已经接近历史极高区间，说明目前权益类资产的相对价值显著上升，虽然当前市场面临经济增速下行、贸易战冲击等诸多不利因素，市场情绪也十分悲观，但市场估值也蕴含了上述悲观预期，我们相信金融资产的运行具有均值回复的特征，当前对权益市场不必过度悲观。结构上，相对看好5G、军工、计算机、新能源等成长板块龙头，同时关注汽车、建材、券商等政策敏感型资产。可转债方面，我们看到2018年底、2019年初新发个券债性保护优化，上市以后定价较低，具备低绝对价格、低转股溢价率、较高到期收益率的特点，性价比较好，2018年11月以来大量的新券发行上市以及几只大盘银行转债的发行预期，使得可转债市场估值压缩至低位，2018年我们看到20多个下修转股价的案例，转债的条款保护生效，当前可转债市场呈现类似2008年的底部特征。考虑到纯债收益率下行幅度较大，配置可转债的机会成本也大幅降低，在向风险资产切换但市场波动率依然较高的阶段，可转债配置价值突出。2019年上半年，南方永利基金纯债方面将在控制好信用风险的前提下，积极在一二级市场上挖掘有利差压缩空间的信用债，在获取票息收益的同时把握信用利差修复的行情；权益方面将主要从绝对收益的角度出发，重点把握可转债市场底部的机会，精选个券，增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次；基金合同生效满6个月后，若基金在每季度最后一个交易日收盘后某类基金份额类别每10份基金份额可分配利润金额高于0.05元(含)，则基金须在15个工作日之内进行

该基金份额类别的收益分配，各基金份额类别每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 80%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018 年，本基金托管人在对南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的管理人——南方基金管理股份有限公司在南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，南方永利 1 年定期开放债券型证券投资基金（LOF）对基金份额持有人未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）2018年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金2018年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第23152号“标准无保留意见的审计报告”。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,440,835.64	1,250,648.68
结算备付金	7,159,418.93	1,936,699.22
存出保证金	13,230.46	16,822.58
交易性金融资产	128,919,800.26	127,658,939.44
其中：股票投资	816,245.76	7,573,857.88
基金投资	-	-
债券投资	125,090,154.50	120,085,081.56
资产支持证券投资	3,013,400.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,781,312.12	-
应收利息	2,707,427.04	1,556,889.13
应收股利	-	-

应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	145,022,024.45	132,419,999.05
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	59,400,000.00	14,000,000.00
应付证券清算款	5,691,787.13	25,852.08
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	47,837.79	69,644.27
应付托管费	13,667.95	19,898.37
应付销售服务费	669.04	1,221.97
应付交易费用	1,678.89	9,519.50
应交税费	16,295.72	-
应付利息	-15,319.73	-6,463.02
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	284,000.00	354,000.00
负债合计	65,440,616.79	14,473,673.17
所有者权益：		
实收基金	82,081,501.28	120,027,735.23
未分配利润	-2,500,093.62	-2,081,409.35
所有者权益合计	79,581,407.66	117,946,325.88
负债和所有者权益总计	145,022,024.45	132,419,999.05

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，南方永利 1 年定期开放债券（LOF）A 份额净值 0.970 元，基金份额总额 80,044,476.97 份；南方永利 1 年定期开放债券（LOF）C 份额净值 0.956 元，基金份额总额 2,037,024.31 份；总份额合计 82,081,501.28 份。

7.2 利润表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	1,350,046.93	7,541,990.11
1. 利息收入	5,762,736.80	5,927,327.95
其中：存款利息收入	54,284.00	56,853.55
债券利息收入	5,663,871.60	5,776,501.62
资产支持证券利息收入	44,581.20	-
买入返售金融资产收入	-	93,972.78
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-4,172,043.68	6,756.33
其中：股票投资收益	-2,257,149.03	221,930.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,019,864.46	-259,282.18
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	104,969.81	44,108.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-240,654.98	1,607,905.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	8.79	-
减：二、费用	2,625,332.44	2,483,522.96
1. 管理人报酬	701,597.65	927,964.70

2. 托管费	200,456.33	265,132.72
3. 销售服务费	11,354.31	17,231.17
4. 交易费用	18,463.75	46,037.03
5. 利息支出	1,288,169.98	767,967.34
其中：卖出回购金融资产支出	1,288,169.98	767,967.34
6. 税金及附加	20,113.82	-
7. 其他费用	385,176.60	459,190.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,275,285.51	5,058,467.15
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,275,285.51	5,058,467.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方永利1年定期开放债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	120,027,735.23	-2,081,409.35	117,946,325.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,275,285.51	-1,275,285.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37,946,233.95	856,601.24	-37,089,632.71
其中：1. 基金申购款	575,136.84	-13,162.87	561,973.97
2. 基金赎回款	-38,521,370.79	869,764.11	-37,651,606.68
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	82,081,501.28	-2,500,093.62	79,581,407.66
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	158,428,786.72	-8,810,196.70	149,618,590.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,058,467.15	5,058,467.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-38,401,051.49	1,670,320.20	-36,730,731.29
其中：1. 基金申购款	758,276.08	-30,276.31	727,999.77
2. 基金赎回款	-39,159,327.57	1,700,596.51	-37,458,731.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	120,027,735.23	-2,081,409.35	117,946,325.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松 _____ 徐超 _____ 徐超
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，

持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《南方基金管理有限公司法定名称变更的公告》，公司名称由“南方基金管理有限公司”变更为“南方基金管理股份有限公司”，公司股权结构等事项未发生变化，并已于2018年1月4日在深圳市市场监督管理局完成相应变更登记手续。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	786,476.50	10.74%	5,146,091.54	26.91%

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	-5,283.96	-787.22%	-5,796.25	-4,531.51%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,665.13	11.56%	-512.29	-31.41%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	701,597.65	927,964.70
其中：支付销售机构的客户维护费	261,067.61	340,995.16

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	200,456.33	265,132.72

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方永利 1 年定期开	南方永利 1 年定期开	合计

	放债券(LOF)A	放债券(LOF)C	
中国工商银行	-	3,524.31	3,524.31
南方基金	-	1,241.24	1,241.24
合计	-	4,765.55	4,765.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方永利1年定期开放债券(LOF)A	南方永利1年定期开放债券(LOF)C	合计
中国工商银行	-	4,200.61	4,200.61
南方基金	-	2,240.85	2,240.85
兴业证券	-	72.79	72.79
合计	-	6,514.25	6,514.25

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给南方基金,再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.40%。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值×约定年费率/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,440,835.64	8,385.70	1,250,648.68	22,715.69

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行约定利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018年12月21日	2019年1月18日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额59,400,000.00元，截至2019年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为3,955,609.26元，属于第二层次的余额为124,964,191.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次15,825,308.84元，第二层次111,833,630.60元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	816,245.76	0.56
	其中：股票	816,245.76	0.56
2	固定收益投资	128,103,554.50	88.33
	其中：债券	125,090,154.50	86.26
	资产支持证券	3,013,400.00	2.08
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,600,254.57	5.93
7	其他资产	7,501,969.62	5.17
8	合计	145,022,024.45	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	816,245.76	1.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	816,245.76	1.03

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	601336	新华保险	19,324	816,245.76	1.03
---	--------	------	--------	------------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601128	常熟银行	2,971,528.08	2.52
2	600845	宝信软件	1,193,822.49	1.01
3	601138	工业富联	13,770.00	0.01
4	601319	中国人保	10,020.00	0.01
5	601577	长沙银行	7,990.00	0.01

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601128	常熟银行	2,617,792.31	2.22
2	601336	新华保险	1,505,973.00	1.28
3	600845	宝信软件	952,134.23	0.81
4	600703	三安光电	524,072.33	0.44
5	002241	歌尔股份	495,964.00	0.42
6	600028	中国石化	370,138.15	0.31
7	000089	深圳机场	290,512.50	0.25
8	601318	中国平安	258,677.60	0.22
9	600219	南山铝业	249,322.73	0.21
10	601138	工业富联	22,612.00	0.02
11	601319	中国人保	22,260.00	0.02
12	601577	长沙银行	11,460.00	0.01

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,197,130.57
卖出股票收入（成交）总额	7,320,918.85

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,766,739.60	2.22
	其中：政策性金融债	1,766,739.60	2.22
4	企业债券	107,053,451.40	134.52
5	企业短期融资券	9,069,200.00	11.40
6	中期票据	4,060,400.00	5.10
7	可转债（可交换债）	3,140,363.50	3.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	125,090,154.50	157.19

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112384	16 歌尔 01	79,000	7,868,400.00	9.89
2	136205	16 龙盛 01	70,000	6,991,600.00	8.79
3	136175	16 搜候债	70,000	6,990,200.00	8.78
4	136089	15 绿地 01	60,980	5,790,051.00	7.28
5	136177	16 电气债	53,070	5,304,346.50	6.67

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	139070	万科优 10	20,000	2,008,800.00	2.52
2	139071	万科 23A1	10,000	1,004,600.00	1.26

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,230.46
2	应收证券清算款	4,781,312.12
3	应收股利	-
4	应收利息	2,707,427.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,501,969.62

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113018	常熟转债	959,604.30	1.21
2	110032	三一转债	412,501.20	0.52
3	123006	东财转债	403,645.20	0.51

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方永利1年定期开放债券（LOF）A	1,525	52,488.18	10,040,499.09	12.54%	70,003,977.88	87.46%
南方永利1年定期开放债券（LOF）C	81	25,148.45	-	-	2,037,024.31	100.00%
合计	1,606	51,109.28	10,040,499.09	12.23%	72,041,002.19	87.77%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	肖唯物	231,000.00	15.96%
2	陈学俊	125,000.00	8.64%
3	宋宁生	108,700.00	7.51%
4	朱莉莉	97,960.00	6.77%
5	王喜瑞	81,656.00	5.64%
6	马建林	70,000.00	4.84%
7	黄穗玲	69,500.00	4.80%
8	温志伟	64,400.00	4.45%
9	郁鸿逵	60,007.00	4.15%
10	王东方	37,000.00	2.56%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持	南方永利1年定期开放债券（LOF）A	32,448.06	0.0405%

有本基金	南方永利1年定期开放债券 (LOF) C	-	-
	合计	32,448.06	0.0405%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方永利1年定期开放债券 (LOF) A	南方永利1年定期开放债券 (LOF) C
基金合同生效日(2013年4月25日)基金份额总额	6,535,978,820.58	-
本报告期期初基金份额总额	116,305,644.82	3,722,090.41
本报告期基金总申购份额	550,930.74	24,206.10
减：报告期基金总赎回份额	36,812,098.59	1,709,272.20
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	80,044,476.97	2,037,024.31

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务6年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币54,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	6,534,442.35	89.26%	5,955.18	887.22%	-
华泰证券	1	786,476.50	10.74%	-5,283.96	-787.22%	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比, 并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实, 投资建议是否准确;
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	407,196,186.70	71.12%	7,096,200,000.00	93.46%	-	-
华泰证券	165,328,201.79	28.88%	496,751,000.00	6.54%	-	-